

Visítalo en: <http://www.labolsa.com/foro/mensajes/1210113260/>

Desde luego que publicaciones que expliquen cómo..

- [amenophis] -

- 00:34 7/may/2008

se puede hacer eso, no existen.

Hasta donde yo sé, cualquier estrategia de delta neutral, implica un riesgo: el de equivocarte cuando neutralices la delta.

Esa posición de la que hablas, está bloqueada tal como está. Cualquier cosa que hagas dentro de esa estrategia, significa desbloquearla y por tanto, implica riesgo.

La única forma de vender volatilidad, es vender opciones. Si añades a esa posición que describes la venta de opciones, estás introduciendo un riesgo que no queda cubierto por esa posición cerrada de 1000 puntos de beneficio.

No sé si eso que te explicó ese asesor, es posible hacerlo o no. Si te dijo que se podía, imagino que se podrá hacer. Pero yo no sé cómo se hace.

Eso sí: sé a quién puedo preguntarle si se puede hacer, y en caso de que se pueda, sabrá cómo.

Sé cómo se hace para neutralizar la delta, pero nunca he sabido ni me he preocupado de saber cómo se neutraliza la gamma. Es posible, que, mediante la neutralización de las dos se pueda hacer eso que dices (en cuyo caso, lo realmente difícil sería ser capaz de tener esa posición bloqueada).

En todo caso, esa posición bloqueada no te hace ganar 1000 puntos. Los puntos que ganes, dependerán de cuánto hayas pagado por las call 13000, que será el coste de esa posición.

Saludos.

.....